

DAFTAR ISI

| | |
|---|-------------|
| HALAMAN JUDUL | i |
| HALAMAN PENGESAHAN | ii |
| HALAMAN PERNYATAAN | iii |
| HALAMAN PERSEMBAHAN | iv |
| HALAMAN MOTTO | v |
| KATA PENGANTAR | vi |
| DAFTAR ISI | viii |
| DAFTAR GAMBAR | x |
| DAFTAR TABEL | xi |
| INTISARI | xii |
| ABSTRACT | xiii |
| I PENDAHULUAN | 1 |
| 1.1. Latar Belakang Masalah | 1 |
| 1.2. Tujuan Penulisan | 2 |
| 1.3. Pembatasan Masalah | 3 |
| 1.4. Tinjauan Pustaka | 3 |
| 1.5. Metode Penulisan | 4 |
| 1.6. Sistematika Penulisan | 4 |
| II LANDASAN TEORI | 6 |
| 2.1. Variabel Random Kontinu | 6 |
| 2.2. Ekspektasi Variabel Random Kontinu | 8 |
| 2.3. <i>Moment Generating Function</i> | 9 |
| 2.4. Fungsi Karakteristik | 10 |
| 2.5. Transformasi Variabel Random Kontinu | 10 |
| 2.5.1. Teknik cdf | 11 |
| 2.5.2. Teknik pdf | 11 |
| 2.5.3. Transformasi Esscher | 12 |
| 2.6. Ukuran Risiko | 12 |
| 2.6.1. <i>Value-at-Risk</i> (VaR) | 13 |
| 2.6.2. <i>Tail-value-at-risk</i> (TVaR) | 13 |
| 2.6.3. Ukuran risiko terdistorsi | 14 |
| 2.7. Estimasi Parameter | 18 |
| 2.7.1. Uji Kecocokan Distribusi | 19 |

| | |
|---|-----------|
| III UKURAN RISIKO GLUEVAR DAN APLIKASINYA PADA DISTRIBUSI LOG-ELLIPTICAL | 20 |
| 3.1. Ukuran Risiko GlueVaR | 20 |
| 3.2. Distribusi <i>Elliptical</i> | 25 |
| 3.3. Distribusi Log- <i>Elliptical</i> | 29 |
| 3.4. GlueVaR pada Distribusi Log- <i>Elliptical</i> | 31 |
| 3.4.1. GlueVaR pada Distribusi Log-Normal | 34 |
| 3.4.2. GlueVaR pada Distribusi Log-Laplace | 35 |
| 3.5. Pengaruh Parameter GlueVaR Log-Elliptical | 38 |
| IV STUDI KASUS | 41 |
| 4.1. Deskripsi Data | 41 |
| 4.2. Uji Kecocokan Distribusi Data Besar Klaim | 42 |
| 4.3. Aplikasi Ukuran Risiko GlueVaR | 43 |
| V PENUTUP | 44 |
| 5.1. Kesimpulan | 44 |
| 5.2. Saran | 45 |
| DAFTAR PUSTAKA | 46 |
| A FUNGSI INDIKATOR | 47 |
| B FUNGSI GAMMA | 48 |
| C DISTRIBUSI KONTINU | 50 |
| 3.1. Distribusi <i>Elliptical</i> | 50 |
| 3.1.1. Distribusi normal - $X \sim N(\mu, \sigma^2)$ | 50 |
| 3.1.2. Distribusi Laplace - $X \sim L(\mu, \sigma^2)$ | 51 |
| 3.2. Distribusi Log- <i>Elliptical</i> | 52 |
| 3.2.1. Distribusi log-normal - $X \sim LN(\mu, \sigma^2)$ | 52 |
| 3.2.2. Distribusi log-Laplace - $X \sim LL(\mu, \sigma^2)$ | 52 |
| D SINTAKS MLE DISTRIBUSI LOG-NORMAL DAN DISTRIBUSI LOG-LAPLACE | 53 |
| E SINTAKS GLUEVAR DISTRIBUSI LOG-NORMAL DAN DISTRIBUSI LOG-LAPLACE | 54 |
| F SINTAKS APLIKASI GLUEVAR DENGAN PACKAGE SHINY | 56 |
| G DATA BESAR KLAIM PT. ASURANSI JASA INDONESIA CABANG YOGYAKARTA TAHUN 2010-2015 | 65 |
| H TABEL UJI KOLMOGOROV-SMIRNOV | 66 |